

朝陽科技大學
112學年度第1學期教學大綱

當期課號	7569	中文科名	投資管理專題研究
授課教師	柯俊禎	開課單位	財務金融系
學分數	3	修課時數	3
		開課班級	碩士班2年級 A班
修習別	專業選修		
類別	一般課程		

本課程培養學生下列知識：

本課程主要目的是讓同學了解投資組合的分析與管理能力，繼而對投資組合理論與實證做詳細的認知，隨後探討證券分析與資產訂價以了解市場效率的重要性，進而介紹金融商品交易策略與評估、之後再藉由資產配置以了解理財規劃的重要性，最後探究投資人行為財務以規避錯誤投資決策。

- 1.熟悉投資組合理論與實證
- 2.熟悉市場效率性與證券分析
- 3.熟悉金融商品交易策略與評估
- 4.熟悉資產配置
- 5.熟悉行為財務

This course includes: 1. Approaches to Valuation/Risk and Return; 2. Theory/Estimation of Discount Rates/Understanding Financial Statements/Estimation of Cashflows/Estimation of Growth Rates; 3. Market Efficiency/Definition and Tests; 4. The Evidence Dividend Discount Models/Free Cashflows to Equity Discount Models/Valuing a Firm; 5. Portfolio management/Performance Evaluation.

每週授課主題

- 第01週：投資概論
- 第02週：投資概論
- 第03週：金融商品
- 第04週：金融商品
- 第05週：證券市場發行與流通
- 第06週：證券市場發行與流通
- 第07週：證券市場發行與流通
- 第08週：證券市場發行與流通
- 第09週：報酬率與風險
- 第10週：報酬率與風險
- 第11週：證券投資組合
- 第12週：證券投資組合
- 第13週：股價與報酬率模式
- 第14週：股價與報酬率模式
- 第15週：效率市場
- 第16週：併購實務
- 第17週：期末報告討論
- 第18週：企業參訪

成績及評量方式

- 出席與課堂參與：30%
- 期末報告：50%
- 學習態度：20%

證照、國家考試及競賽關係

- 證券交易分析人員
- 證券商業務員

主要教材

- 1.投資學基礎與應用徐俊明新陸書局978986576116520173(教科書)

參考資料

本課程無參考資料!

建議先修課程

本課程無建議先修課程

教師資料

教師網頁：<http://www.cyut.edu.tw/~jimchen/>

E-Mail：jimchen@cyut.edu.tw

Office Hour：

星期二,第5~6節,地點:T2-959;

星期四,第3~4節,地點:T2-959;

分機:4390

[\[關閉\]](#) [\[列印\]](#)

尊重智慧財產權，請勿不法影印。